

Předložená práce se zabývá výběrem volitelných parametrů částečného zapomínání. Hlavním cílem je vytvoření algoritmu pro optimální vývoj těchto parametrů v čase, který bude lepší, než použití konstantních parametrů. K tomuto účelu je nejprve představeno bayesovské dynamické rozhodování, následováno obecnými principy zapomínání při odhadování pomalu se měnících parametrů modelu a metodou částečného zapomínání. V práci je důvod usnadnění výpočtů uvažována exponenciální rodina hustot. Použitá metoda pro optimální volbu volitelných parametrů částečného zapomínání je nejprve popsána matematicky s využitím bayesovského učení. Hlavní důraz je kladen zejména na volbu zapomínacího faktoru, jehož výběr je považován za bayesovské testování hypotéz s tím, že množina uvažovaných hypotéz se v čase vyvíjí. Zapomínání je aplikováno též na hypotézy. Veškeré představené postupy jsou následně aplikovány na normální regresní model. Obecnost teoretické části však umožňuje jejich použití i pro jiné, např. markovské, modely. Algoritmus je následně naprogramován v jazyce Python a testován jak na skutečných dopravních datech, tak na datech uměle vytvořených.